

广发优选配置两年封闭运作混合型基金中  
基金（FOF-LOF）  
A 类基金份额  
上市交易公告书

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

A 类基金份额注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：上海证券交易所

上市时间：2021 年 11 月 19 日

公告日期：2021 年 11 月 16 日

## 目录

一、	重要声明与提示 .....	1
二、	基金概览 .....	1
三、	基金的募集与上市交易 .....	2
四、	持有人户数、持有人结构及前十名持有人 .....	7
五、	基金主要当事人简介 .....	8
六、	基金合同摘要 .....	11
七、	基金财务状况 .....	11
八、	基金投资组合 .....	12
九、	重大事件揭示 .....	16
十、	基金管理人承诺 .....	16
十一、	基金托管人承诺 .....	16
十二、	基金上市推荐人承诺 .....	17
十三、	备查文件目录 .....	17
附件：	基金合同摘要 .....	18

## 一、 重要声明与提示

《广发优选配置两年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）A 类基金份额上市交易公告书》（以下简称“本公告”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 1 号〈上市交易公告书的内容与格式〉》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，本基金管理人广发基金管理有限公司的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

本公告书第七节“基金财务状况”未经审计。凡本公告未涉及的有关内容，请投资者详细查阅 2021 年 9 月 30 日刊登在中国证监会规定媒介上的《广发优选配置两年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）招募说明书》。

## 二、 基金概览

1、基金名称：广发优选配置两年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）

（1）A类基金份额：

基金代码：501212

基金简称：广发优选配置两年封闭混合（FOF-LOF）A

基金场内简称：优选配置（扩位简称：“广发优选配置FOF”）

（2）C类基金份额：

基金代码：013825

基金简称：广发优选配置两年封闭混合（FOF-LOF）C

2、基金类型：基金中基金（FOF）

3、基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效后的前两年为封闭运作期。在封闭运作期内，本基金不办理申购与赎回业务。封闭运作期内A类基金份额上市交易后，投资者可将其持有的场外A类基金份额通过办理跨系统转托管业务转至场内后上市交易。封闭运作期届满后，本基金转为上市开放式基金（LOF），基金名称调整为“广发优选配置混合型基金中基金（FOF-LOF）”，并接受场外、场内申购赎回。基金管理人有权在封闭运作期届满前召集基金份额持有人大会，审议是否在

封闭运作期届满后延长封闭运作期及延长封闭运作期的期限，具体事项由基金管理人另行公告。

4、基金存续期限：不定期

5、基金份额总额：

2021年11月12日，本基金总份额为1,024,499,282.94份，其中A类基金份额984,930,700.39份，C类基金份额39,568,582.55份。

6、基金份额净值：

2021年11月12日，A类基金份额净值1.0036，C类基金份额净值1.0035

7、本次上市A类基金份额：252,683,535.00份

8、上市交易的证券交易所：上海证券交易所

9、上市交易日期：2021年11月19日

10、基金管理人：广发基金管理有限公司

11、基金托管人：中国建设银行股份有限公司

12、上市推荐人：广发证券股份有限公司

13、本次上市交易的A类基金份额登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

### 三、 基金的募集与上市交易

#### （一） 本基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和注册文号：中国证券监督管理委员会证监许可[2021]3046号。

2、基金运作方式：契约型开放式。

基金合同生效后的前两年为封闭运作期。在封闭运作期内，本基金不办理申购与赎回业务。

封闭运作期内A类基金份额上市交易后，投资者可将其持有的场外A类基金份额通过办理跨系统转托管业务转至场内后上市交易。封闭运作期届满后，本基金转为上市开放式基金（LOF），基金名称调整为“广发优选配置混合型基金中基金（FOF-LOF）”，并接受场外、场内申购赎回。

基金管理人有权在封闭运作期届满前召集基金份额持有人大会，审议是否在封闭运作期届满后延长封闭运作期及延长封闭运作期的期限，具体事项由基金管理人另行公告。

3、基金合同期限：不定期。

4、发售方式：本基金A类基金份额通过场内、场外两种方式公开发售，C类基金份额仅通过场外发售。

5、发售日期：2021年10月18日至2021年10月29日。

6、发售价格：人民币1.00元。

7、发售期限：共计发售10个工作日。

8、A类基金份额发售机构

(1) 场外发售机构

①直销机构：广发基金管理有限公司

②场外代销机构：爱建证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、北京创金启富基金销售有限公司、北京蛋卷基金销售有限公司、北京度小满基金销售有限公司、北京格上富信基金销售有限公司、北京恒天明泽基金销售有限公司、北京虹点基金销售有限公司、北京汇成基金销售有限公司、北京钱景基金销售有限公司、北京唐鼎耀华基金销售有限公司、北京展恒基金销售股份有限公司、渤海证券股份有限公司、财通证券股份有限公司、财信证券有限责任公司、大通证券股份有限公司、大同证券有限责任公司、德邦证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司、鼎信汇金（北京）投资管理有限公司、东北证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东莞证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、泛华普益基金销售有限公司、方德保险代理有限公司、方正证券股份有限公司、凤凰金信（银川）基金销售有限公司、光大证券股份有限公司、广发银行股份有限公司、广发证券股份有限公司、国都证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、国融证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、海银基金销售有限公司、和耕传承基金销售有限公司、恒泰证券股份有限公司、弘业期货股份有限公司、华安证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、华福证券有限责任公司、华金证券股份有限公司、华林证券股份有限公司、华龙证券股份有限公司、华融证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、华夏银行股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、济安财富（北京）基金销售有限公司、嘉实财富管理有限公司、江海证券有限公司、江苏汇林保大基金销售有限公司、江苏江南农村商业银行股份有限公司、京东肯特瑞基金销售有限公司、开源证券股份有限公司、蚂蚁（杭州）基金销售有限公司、民商基金销售（上海）有限公司、民生证券股份有限公司、南京苏宁基金销售有限公司、南京证券股份有限公司、诺亚正行基金销售有限公司、平安银行股份有限公司、平安证券股份有限公司、浦领基金销售有限公司、厦门市鑫鼎盛控股有限公司、厦门银行股份有限公司、山西证券股份有限公司、上海好买基金销售有限公司、上海华夏财富投资管理有限公司、上海基煜基金销售有限公司、上海利得基金销售有限公司、上海联泰基金销售有限公司、上海陆金所基金销售有限公司、上海农村商业银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、上海天天基金销售有限公司、上海挖财基金销售有限公司、上海万得基金销售有限公司、上海银行股份有限公司、上海长量基金销售有限公司、上海证券有限责任公司、上海中正达广基金销售有限公司、申万宏源西部证券有限公司、申万宏源证券有限公司、

深圳市金斧子基金销售有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、深圳信诚基金销售有限公司、深圳众禄基金销售股份有限公司、世纪证券有限责任公司、首创证券有限责任公司、腾安基金销售（深圳）有限公司、天风证券股份有限公司、通华财富（上海）基金销售有限公司、万家财富基金销售（天津）有限公司、万联证券股份有限公司、五矿证券有限公司、西部证券股份有限公司、西藏东方财富证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、新时代证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、兴业银行股份有限公司、兴业证券股份有限公司、阳光人寿保险股份有限公司、一路财富（北京）基金销售有限公司、宜信普泽（北京）基金销售有限公司、奕丰基金销售有限公司、英大证券有限责任公司、粤开证券股份有限公司、长城国瑞证券有限公司、长城证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、招商银行股份有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、浙商证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国中金财富证券有限公司、中航证券有限公司、中欧钱滚滚基金销售（上海）有限公司、中山证券有限责任公司、中泰证券股份有限公司、中天证券股份有限公司、中信建投期货有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信期货有限公司、中信银行股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中信证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司、中银国际证券股份有限公司、中原证券股份有限公司、中证金牛（北京）投资咨询有限公司、珠海盈米基金销售有限公司等销售机构。

（2）场内发售机构：本基金的场内发售机构为具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员单位。

#### 9、C类基金份额发售机构

（1）直销机构：广发基金管理有限公司

（2）场外代销机构：爱建证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、北京创金启富基金销售有限公司、北京蛋卷基金销售有限公司、北京度小满基金销售有限公司、北京格上富信基金销售有限公司、北京恒天明泽基金销售有限公司、北京虹点基金销售有限公司、北京汇成基金销售有限公司、北京坤元基金销售有限公司、北京钱景基金销售有限公司、北京唐鼎耀华基金销售有限公司、北京展恒基金销售股份有限公司、渤海证券股份有限公司、财通证券股份有限公司、财信证券有限责任公司、大连银行股份有限公司、大通证券股份有限公司、大同证券有限责任公司、德邦证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司、鼎信汇金（北京）投资管理有限公司、东北证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东莞证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、泛华普益基金销售有限公司、方德保险代理有限公司、方正证券股份有限公司、凤凰金信（银川）基金销售有限公司、光大证券股份有限公司、广发银行股份有限公司、广发证券股份有限公司、国都证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、国融证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限

公司、国信证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、海银基金销售有限公司、和耕传承基金销售有限公司、恒泰证券股份有限公司、弘业期货股份有限公司、洪泰财富(青岛)基金销售有限责任公司、华安证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、华福证券有限责任公司、华金证券股份有限公司、华林证券股份有限公司、华龙证券股份有限公司、华融证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、华夏银行股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、济安财富(北京)基金销售有限公司、嘉实财富管理有限公司、江海证券有限公司、江苏汇林保大基金销售有限公司、江苏江南农村商业银行股份有限公司、江苏苏州农村商业银行股份有限公司、江西银行股份有限公司、金元证券股份有限公司、京东肯特瑞基金销售有限公司、开源证券股份有限公司、蚂蚁(杭州)基金销售有限公司、民商基金销售(上海)有限公司、民生证券股份有限公司、南京苏宁基金销售有限公司、南京证券股份有限公司、诺亚正行基金销售有限公司、平安银行股份有限公司、平安证券股份有限公司、浦领基金销售有限公司、厦门市鑫鼎盛控股有限公司、厦门银行股份有限公司、山西证券股份有限公司、上海好买基金销售有限公司、上海华夏财富投资管理有限公司、上海基煜基金销售有限公司、上海利得基金销售有限公司、上海联泰基金销售有限公司、上海陆金所基金销售有限公司、上海陆享基金销售有限公司、上海农村商业银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、上海天天基金销售有限公司、上海挖财基金销售有限公司、上海万得基金销售有限公司、上海银行股份有限公司、上海长量基金销售有限公司、上海证券有限责任公司、上海中正达广基金销售有限公司、申万宏源西部证券有限公司、申万宏源证券有限公司、深圳市金斧子基金销售有限公司、深圳市金海九州基金销售有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、深圳信诚基金销售有限公司、深圳众禄基金销售股份有限公司、世纪证券有限责任公司、首创证券有限责任公司、腾安基金销售(深圳)有限公司、天风证券股份有限公司、通华财富(上海)基金销售有限公司、万家财富基金销售(天津)有限公司、万联证券股份有限公司、五矿证券有限公司、西部证券股份有限公司、西藏东方财富证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、新时代证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、兴业银行股份有限公司、兴业证券股份有限公司、阳光人寿保险股份有限公司、一路财富(北京)基金销售有限公司、宜信普泽(北京)基金销售有限公司、奕丰基金销售有限公司、英大证券有限责任公司、粤开证券股份有限公司、长城国瑞证券有限公司、长城证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、招商银行股份有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、浙商证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国中金财富证券有限公司、中航证券有限公司、中欧钱滚滚基金销售(上海)有限公司、中山证券有限责任公司、中泰证券股份有限公司、中天证券股份有限公司、中信建投期货有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信期货有限公司、中信银行股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、中信证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司、中原证券股份有限公

司、中证金牛(北京)投资咨询有限公司、珠海盈米基金销售有限公司等销售机构。

10、验资机构名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

11、募集资金总额及入账情况

本基金于2021年10月18日起公开募集，基金募集工作已于2021年10月29日顺利结束。经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为1,024,186,133.38元人民币，折合基金份额1,024,186,133.38份，经基金注册登记人计算并确认的认购资金在募集期间的利息为人民币314,465.02元，折合313,149.56份基金份额。其中A类基金已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币984,629,309.97元，折合984,629,309.97份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币302,705.88元，折合301,390.42份基金份额。C类基金已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额资金为人民币39,556,823.41元，折合39,556,823.41份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币11,759.14元，折合11,759.14份基金份额。本次募集有效认购户数为12,595户，募集总金额合计1,024,500,598.40元人民币，折算成基金份额1,024,499,282.94份。本次募集资金已于2021年11月2日划入基金托管账户。

12、募集备案情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》以及《广发优选配置两年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）基金合同》、《广发优选配置两年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）招募说明书》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理基金备案手续，并于2021年11月2日获书面确认，基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人开始正式管理本基金。

13、基金合同生效日：2021年11月2日

14、基金合同生效日的基金份额总额：本次募集资金及利息结转的基金份额共计1,024,499,282.94份，已全部计入投资者账户，归投资者所有。

## （二）基金上市交易

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：上海证券交易所自律监管决定书[2021]437号。

2、上市交易日期：2021年11月19日。

3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。

4、基金场内简称：优选配置（扩位简称：广发优选配置FOF）。

5、交易代码：501212。

投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与本基金的二级市场交易。

6、本次上市交易A类基金份额：252,683,535.00份。

7、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的A类基金份额登记在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下可将其跨系统转托管至中国证券登记结算有限责任公司上海分公司证券登记系统后，在上海证券交易所上市交易。本基金A类基金份额于2021年11月19日开始办理跨系统转托管业务。本基金C类基金份额不开通跨系统转托管业务。

8、基金净值的披露：基金管理人每个估值日对基金资产估值，用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。本基金A类份额上市交易后，投资者可在每个估值日（T日）后的三个工作日（T+3日）内通过基金管理人网站以及其他规定披露媒介查询到T日的基金份额净值和基金份额累计净值。

#### 四、 持有人户数、持有人结构及前十名持有人

##### （一） 持有人户数

截至 2021 年 11 月 12 日，本基金份额持有人户数为 12,595 户，平均每户持有的基金份额为 81,341.75 份。其中 A 类份额持有人户数为 10,611 户，平均每户持有的基金份额为 92,821.67 份；上市交易的场内 A 类份额持有人户数为 2,999 户，平均每户持有的基金份额为 84,255.93 份。

##### （二） 持有人结构

1、截至 2021 年 11 月 12 日，本基金份额持有人结构如下：

本基金总份额 1,024,499,282.94 份，上市交易的 A 类场内基金份额 252,683,535.00 份。其中机构投资者持有的本次上市交易的 A 类场内基金份额为 40,749,211.00 份，占本次上市交易 A 类场内基金份额比例为 16.13%；个人投资者持有的本次上市交易的 A 类场内基金份额为 211,934,324.00 份，占本次上市交易 A 类场内基金份额比例为 83.87%。

2、截至 2021 年 11 月 12 日，基金管理人的从业人员持有本基金的情况：

基金管理人的基金从业人员持有基金份额 167,238.72 份，占基金份额总量的 0.0163%。基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0 万份；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0 万份。

##### （三）截至 2021 年 11 月 12 日，本基金前十名场内基金份额持有人情况

序号	持有人名称（全称）	持有场内基金份额	占场内基金份额的比例
----	-----------	----------	------------

1	江阴天力燃气输配有限公司	20,009,800.00	7.92%
2	西南证券股份有限公司	19,998,000.00	7.91%
3	冯韶华	10,241,812.00	4.05%
4	梁文成	5,999,000.00	2.37%
5	谭小京	3,976,143.00	1.57%
6	关荆琳	1,988,701.00	0.79%
7	罗强	1,988,611.00	0.79%
8	杨文方	1,723,366.00	0.68%
9	吴金玲	1,488,905.00	0.59%
10	王哲	1,388,951.00	0.55%
合计		68,803,289.00	27.23%

## 五、 基金主要当事人简介

### (一) 基金管理人

#### 1、公司概况

名称：广发基金管理有限公司

法定代表人：孙树明

总经理：王凡

注册资本：14,097.8万元人民币

注册地址：广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-49848（集中办公区）

设立批准文号：中国证监会证监基金字[2003]91号

工商登记注册的法人营业执照文号：914400007528923126

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务

#### 2、股东及其出资比例

股东名称	出资比例
广发证券股份有限公司	54.533%
烽火通信科技股份有限公司	14.187%
深圳市前海香江金融控股集团有限公司	14.187%
广州科技金融创新投资控股有限公司	7.093%

嘉裕元（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	3.87%
嘉裕祥（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	2.23%
嘉裕禾（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	1.55%
嘉裕泓（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	1.19%
嘉裕富（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	1.16%
合 计	100%

### 3、内部组织结构及职能

自成立以来，公司不断致力于健全公司治理结构，严格按照法律法规要求，建立组织架构健全、职能划分明晰、制衡监督有效、内部运作协调、激励约束合理的公司治理架构，保持公司规范运作，保护基金份额持有人利益。公司设置了健全、清晰的组织架构，并根据业务需要进行了合理的职能分工。

公司组织架构主要分为投研条线、市场条线和中后台条线。其中，投研条线包括主动权益、指数投资、量化投资、固定收益投资、国际投资、资产配置、宏观策略、行业研究等职能部门，负责按各自专业分工开展投资研究、投资管理等工作。市场条线包括产品设计、零售业务、机构业务、互联网金融业务、养老金业务、战略与创新业务等职能部门，负责按各自所属客户群体开展产品设计、客户推广和客户服务等工作；中后台条线包括风险管理板块、业务支持板块和管理支持板块，上述板块包含相应职能部门，风险管理板块主要负责投资、产品与市场、运营方面的合规工作、内审稽核、投资风险管理及数据服务等工作，业务支持板块主要负责信息安全与运维、系统开发、数据平台研发、组合交易、会计与结算、注册登记等工作，管理支持板块主要负责规划研究、财务管理、人力行政等工作。

### 4、基金管理业务情况

经中国证监会证监基金字[2003]91号文批准，广发基金管理有限公司于2003年8月5日成立，总部设在广州。公司及旗下子公司目前拥有公募基金管理、社保基金境内委托投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、特定客户资产管理、QDII、RQFII、QFII、受托管理保险资金投资管理人和保险保障基金委托资产管理投资管理人等业务资格，是具备综合资产管理能力与经验的大型基金管理公司。

公司坚持“专业创造价值、客户利益为上”的理念，致力成为多资产、多策略、多市场的领先全能资产管理机构，为投资者创造长期、稳定、可持续的回报，为我国资本市场的繁荣与发展贡献力量。

### 5、信息披露负责人：程才良

咨询电话：020-83936666

### 6、截止2021年10月31日，广发基金管理有限公司总人数732人，其中博士学位22人、硕

士学位506人和学士学位187人。

## 7、本基金经理

杨喆女士，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任国泰君安证券股份有限公司研究所分析师；先后任交银施罗德基金管理有限公司量化投资部投资经理、多元资产管理部副总监、基金经理。现任广发基金管理有限公司资产配置部联席总经理、广发优选配置两年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）基金经理（自2021年11月2日起任职）。

## （二）基金托管人

### 1、基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：李申

联系电话：(021)6063 7102

### 2、主要人员情况

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、全球托管处、养老金托管处、新兴业务处、运营管理处、跨境托管运营处、社保及大客户市场处、托管应用系统支持处、合规监督处等 12 个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工 300 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

### 3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、存托业务等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2021 年一季度末，

中国建设银行已托管 1097 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。截至目前，中国建设银行先后多次被《全球托管人》、《财资》、《环球金融》杂志及《中国基金报》评选为“最佳托管银行”、连续多年荣获中央国债登记结算有限责任公司（中债）“优秀资产托管机构”、银行间市场清算所股份有限公司（上清所）“优秀托管银行”奖项、并在 2017、2019 及 2020 年分别荣获《亚洲银行家》颁发的“最佳托管系统实施奖”、“中国年度托管业务科技实施奖”以及“中国年度托管银行（大型银行）”奖项。

### （三）上市推荐人

公司名称:广发证券股份有限公司

注册地址:广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室

办公地址:广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦

法人:林传辉

联系人:刘珂

客服电话:95575、020-95575 或致电各地营业网点

网址:www.gf.com.cn

### （四）验资机构

名称:安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

办公地址:北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

法人代表:毛鞍宁

电话:020-28812888

传真:020-28812618

经办注册会计师:赵雅、马婧

## 六、 基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

## 七、 基金财务状况

### （一）基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金资产中支付。各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率收取认购费。

### （二）基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

### （三）基金资产负债表

截至公告日前两个工作日即2021年11月12日，本基金的资产负债表（未经审计）如下：

金额单位：人民币元

资产	期末余额	负债和所有者权益	期末余额
<b>资产：</b>		<b>负债：</b>	
银行存款	29,259,572.50	短期借款	
结算备付金		交易性金融负债	
存出保证金		衍生金融负债	
交易性金融资产	999,345,778.32	卖出回购金融资产款	
其中：股票投资	106,700,915.00	应付证券清算款	
债券投资		应付赎回款	
资产支持证券		应付管理人报酬	280,775.99
基金投资	892,644,863.32	应付托管费	54,013.00
衍生金融资产		应付销售服务费	4,337.48
买入返售金融资产		应付交易费用	76,955.77
应收证券清算款		应付税费	
应收利息	26,208.50	应付利息	
应收股利		应付利润	
持有至到期金融资产		其他负债	3,666.63
应收申购款		<b>负债合计</b>	419,748.87
其他资产		<b>所有者权益：</b>	
		实收基金	1,024,499,282.94
		未分配利润	3,712,527.51
		<b>所有者权益合计</b>	1,028,211,810.45
<b>资产总计：</b>	1,028,631,559.32	<b>负债与持有人权益总计：</b>	1,028,631,559.32

## 八、 基金投资组合

截至公告日前两个工作日即2021年11月12日，广发优选配置两年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）（本基金合同自2021年11月2日起生效，本报告期自2021年11月2日至2021年11月12日）的投资组合报告如下：

### （一）报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	106,700,915.00	10.37

	其中：股票	106,700,915.00	10.37
2	基金投资	892,644,863.32	86.78
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	29,259,572.50	2.84
8	其他资产	26,208.50	0.00
9	合计	1,028,631,559.32	100.00

## (二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 1、报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,901,741.00	0.28
C	制造业	62,368,824.00	6.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	834,535.00	0.08
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	401,162.00	0.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,869,437.00	0.28
J	金融业	31,066,661.00	3.02
K	房地产业	883,278.00	0.09
L	租赁和商务服务业	1,788,480.00	0.17

M	科学研究和技术服务业	2,411,380.00	0.23
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	823,307.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	352,110.00	0.03
S	综合	-	-
	合计	106,700,915.00	10.38

## 2、报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

### (三) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	5,100	9,046,278.00	0.88
2	300059	东方财富	250,900	8,889,387.00	0.86
3	300014	亿纬锂能	47,300	6,224,207.00	0.61
4	600036	招商银行	102,400	5,365,760.00	0.52
5	601318	中国平安	89,600	4,534,656.00	0.44
6	300450	先导智能	41,100	3,587,619.00	0.35
7	601012	隆基股份	35,800	3,392,766.00	0.33
8	300122	智飞生物	21,400	2,735,776.00	0.27
9	601166	兴业银行	120,300	2,266,452.00	0.22
10	300316	晶盛机电	26,300	2,175,799.00	0.21

### (四) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### (五) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### (六) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### (七) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### (八) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### （九）报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

- 1、本基金本报告期末未持有股指期货。
- 2、本基金本报告期内未进行股指期货交易。

#### （十）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

- 1、本基金本报告期末未持有国债期货。
- 2、本基金本报告期内未进行国债期货交易。

#### （十一）投资组合报告附注

1、本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局和中国银行保险监督管理委员会（含原中国银行业监督管理委员会、中国保险监督管理委员会）的处罚，兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局和中国人民银行的处罚。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

- 2、本报告期内，基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。
- 3、其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,208.50
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,208.50

#### 4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 九、 重大事件揭示

本基金自基金合同生效至上市交易公告书刊登前未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

## 十、 基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、上海证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

## 十一、 基金托管人承诺

基金托管人就该基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

（二）根据《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金份额净值计算进行监督和核查。如发现基金管理人违反《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定，将及时通知基金管理人纠正；基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人将及时向中国证监会报告。

## 十二、 基金上市推荐人承诺

本基金上市推荐人为广发证券股份有限公司。上市推荐人就基金上市交易事宜出具如下意见：

- 1、本基金上市符合《基金法》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的相关条件；
- 2、基金上市文件真实、准确、完整，符合相关规定要求，文件内所载的资料均经过核实。

## 十三、 备查文件目录

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅。

- (一) 中国证监会批准广发优选配置两年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）募集的文件
- (二) 《广发优选配置两年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）基金合同》
- (三) 《广发优选配置两年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）招募说明书》
- (四) 《广发优选配置两年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）托管协议》
- (五) 法律意见书
- (六) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (七) 基金托管人业务资格批件、营业执照

**风险提示：**基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。投资者在投资基金前应认真阅读基金合同、招募说明书（更新）和基金产品资料概要（更新）等基金法律文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

广发基金管理有限公司  
二〇二一年十一月十六日

## 附件：基金合同摘要

### 一、基金合同当事人的权利与义务

#### (一) 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；
- (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
- (14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

(1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

(4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

(6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

(11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

(13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 20 年以上；

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

(18) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

(23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

(24) 基金在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

(1) 自《基金合同》、《托管协议》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

(2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及

国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户等投资所需账户、为基金办理证券交易资金清算；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

(2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

(4) 除依据《基金法》、《基金合同》、《托管协议》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回价格；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 20 年以上；

(12) 保存基金份额持有人名册；

- (13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；
- (17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；
- (19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；
- (21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### (三) 基金份额持有人

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

同一类别的每份基金份额具有同等的合法权益。本基金 A 类基金份额与 C 类基金份额由于基金份额净值的不同，基金收益分配的金额以及参与清算后的剩余基金财产分配的数量将可能有所不同。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》、《招募说明书》等信息披露文件；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 交纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金的基金份额持有人大会暂不设立日常机构。

### (一) 召开事由

1、除法律法规，基金合同和中国证监会另有规定外，当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止《基金合同》；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式；
- (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准及提高销售服务费率；
- (6) 变更基金类别；

- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- (12) 终止 A 类基金份额上市，但因 A 类基金份额不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的除外；
- (13) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (14) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、在不违反有关法律法规和《基金合同》约定，并对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (2) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；调低销售服务费率；
- (3) 因相应的法律法规、上海证券交易所或登记机构的相关业务规则发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (4) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；
- (5) 《基金合同》明确约定无需召开基金份额持有人大会的情况；
- (6) 基金管理人、登记机构、基金销售机构在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整有关认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则；
- (7) 基金推出新业务或服务，或调整基金份额类别设置；
- (8) 本基金的基金管理人代表本基金基金份额持有人的利益，参与所持有基金的基金份额持有人大会，并在遵循本基金基金份额持有人利益优先原则的前提下行使相关投票权利；
- (9) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## （二）会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

2、基金管理人未按规定召集或不能召开时，由基金托管人召集。

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开，并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

## （三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在规定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限

等)、送达时间和地点;

(5) 会务常设联系人姓名及联系电话;

(6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;

(7) 召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下,由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人,还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督;如召集人为基金托管人,则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督;如召集人为基金份额持有人,则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的,不影响表决意见的计票效力。

(四) 基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规和监管机关允许的其他方式召开,会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席,现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会,基金管理人或基金托管人不派代表列席的,不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时,可以进行基金份额持有人大会议程:

(1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定,并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符;

(2) 经核对,汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示,有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50% (含 50%)。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或基金合同约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或基金合同约定的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时,通讯开会的方式视为有效:

(1) 会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后,在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告;

(2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）；

(4) 上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记注册机构记录相符。

参加基金份额持有人大会的持有人的基金份额低于第 1 款第（2）项、或者第 2 款第（3）项规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上基金份额的持有人参加，方可召开。

3、在法律法规及监管机构允许的前提下，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开，基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，在法律法规及监管机构允许的前提下，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

## （五）议事内容与程序

### 1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

### 2、议事程序

#### （1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

## （2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

## （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除基金合同另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

## （七）计票

### 1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

（2）监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

（3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

（4）计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

### 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

## （八）生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在规定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

## （九）实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例：

1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额 10% 以上（含 10%）；

2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

3、通讯开会的直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

4、在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一、召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；

5、现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50% 以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人；

6、一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过；

7、特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。

同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。

（十）基金管理人代表本基金出席本基金持有的基金份额持有人大会并参与表决的特别约定

本基金持有的基金召开基金份额持有人大会时，本基金管理人应代表本基金基金份额持有人的利益参与所持有基金的份额持有人大会，并在遵循本基金份额持有人利益优先原则的前提下行使相关投票权利。本基金管理人需将表决意见事先征求基金托管人的意见，并将表决意见在定期报告中予以披露。

法律法规对于本基金参与本基金持有的基金召开基金份额持有人大会的程序或要求另有规定的，从其规定。

（十一）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等

规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人经与基金托管人协商一致报监管机关并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

### 三、基金收益分配原则、执行方式

#### （一）基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准。若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，登记在注册登记系统基金份额持有人基金账户下的基金份额可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在证券登记系统基金份额持有人上海证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，经与基金托管人协商一致，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

#### （二）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

#### （三）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### （四）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金

红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

#### （五）实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。

### 四、与基金财产管理、运作有关费用的提取、支付方式与比例

#### （一）基金管理人的管理费

本基金投资于本基金管理人所管理的基金的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人自身管理的其他基金份额所对应资产净值的剩余部分

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

#### （二）基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人自身托管的其他基金份额所对应资产净值的剩余部分

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

#### （三）基金销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金

份额资产净值的 0.40%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

#### （四）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### （五）实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见招募说明书的规定。

#### （六）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

### 五、基金资产的投资方向和投资限制

#### （一）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（包括 QDII 基金、香港互认基金及其他经中国证监会依法核准或注册的基金）、国内依法发行上市的股票（包括创业板及其他依法上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券以及经法律法规或中国证监会允

许投资的其他债券类金融工具）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

本基金为混合型基金中基金（FOF），投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于股票型证券投资基金的比例合计为基金资产的 30%-80%，投资于货币市场基金的比例不高于基金资产的 15%；投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%；但封闭运作期到期前的两个月内和到期后的两个月内不受前述比例限制。本基金封闭期届满转型为“广发优选配置混合型基金中基金（FOF-LOF）”后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金类资产范围不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等资金类别，法律法规另有规定的从其规定。

如未来法律法规或监管机构对投资比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。

## （二） 投资限制

### 1、 组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于股票型证券投资基金的比例合计为基金资产的 30%-80%，投资于货币市场基金的比例不高于基金资产的 15%；投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%；但封闭运作期到期前的两个月内和到期后的两个月内不受前述比例限制；

（2）本基金封闭期届满转型为“广发优选配置混合型基金中基金（FOF-LOF）”后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金类资产范围不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等资金类别，法律法规另有规定的从其规定；

（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值（同一家公司在境内和香港同时上市的 A+H 股合并计算）不超过基金资产净值的 10%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在境内和香港同时上市的 A+H 股合并计算），不超过该证券的 10%；

(5) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(6) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(7) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(8) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(9) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(10) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(11) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(12) 本基金持有单只基金的市值，不得超过基金资产净值的 20%，且不得持有其他基金中基金；

(13) 除 ETF 联接基金外，本基金管理人管理的全部基金中基金持有单只基金不得超过被投资基金净资产的 20%，被投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准；

(14) 本基金投资其他基金，被投资基金的运作期限应当不少于 1 年、最近定期报告披露的基金净资产应不低于 1 亿元；

(15) 本基金投资于封闭运作基金、定期开放基金等流通受限基金的资产占基金资产净值的比例不得超过 10%；

(16) 转型为“广发优选配置混合型基金中基金（FOF-LOF）”后，本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

(17) 转型为“广发优选配置混合型基金中基金（FOF-LOF）”后，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人

不得主动新增流动性受限资产的投资；

(18) 转型为“广发优选配置混合型基金中基金（FOF-LOF）”后，本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与本基金合同约定的投资范围保持一致；

(19) 在封闭运作期内，基金总资产不得超过基金净资产的 200%，转型为“广发优选配置混合型基金中基金（FOF-LOF）”后，基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(20) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；

(21) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合前款第(12)、(13)条规定的比例的，基金管理人应当在 20 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。除上述第(9)、(12)、(13)、(17)、(18)项规定的情形外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (5) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (6) 法律、行政法规和国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项

进行审查。

3、法律法规或监管部门取消上述组合限制、禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求，本基金可不受相关限制。法律法规或监管部门对上述组合限制、禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求进行变更的，本基金可以变更后的规定为准；经与基金托管人协商一致，基金管理人可依据法律法规或监管部门规定直接对基金合同进行变更，该变更无须召开基金份额持有人大会审议。

## **六、基金净值的计算方法和公告方式**

### **（一）基金资产净值的计算方法**

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### **（二）基金净值信息的公告方式**

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在规定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的3个工作日内，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的3个工作日内，在规定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

## **七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算**

### **（一）《基金合同》的变更**

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，生效后方可执行，自表决通过之日起五日内报中国证监会备案，自决议生效之日起两日内在规定媒介公告。

### **（二）《基金合同》的终止事由**

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人

承接的；

3、连续五十个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元人民币情形的；

4、《基金合同》约定的其他情形；

5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### （三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组成员：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有证券、期货相关业务资格的规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4、基金财产清算程序：

（1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

（5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对基金财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

### （四）清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

### （五）基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### （六）基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

#### （七）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 20 年以上。

### 八、争议的处理和适用的法律

双方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律管辖。

### 九、基金合同存放地和投资者取得合同的方式

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。